

Fecha de publicación: 26 de Abril de 2004
 Fecha de Información: 22 de Abril de 2004 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$149.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37.9	4.6	2.8	36.1	40.7
15-35	58.5	57.6	9.1	10.0	67.6
36-60	9.0	14.1	5.1	-	14.1
61-90	15.0	15.1	0.1	-	15.1
91-180	8.5	10.6	2.1	-	10.6
>180	0.5	1.1	0.6	-	1.1
Total	129.4	103.2	19.9	46.1	149.3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4.1 %	3.2 %
15-35	2.3 %	2.0 %
36-60	4.6 %	4.2 %
61-90	4.4 %	3.3 %
91-180	6.9 %	6.2 %
>180	7.5 %	7.3 %
Total	4.6 %	3.0 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	19 al 23 de Abril				26 al 30 de Abril				3 al 7 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	21	63	415	312	16	62	240	211	15	28	341	283
Real	60	17	91	194	51	5	64	94	25	12	81	139
Total	81	81	505	505	67	67	305	305	40	40	422	422

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 23 de abril se presenta la proyección de vencimientos.